

泰达宏利中证财富大盘指数证券投资基金 2011 年年度报告

2011 年 12 月 31 日

基金管理人：泰达宏利基金管理有限公司

基金托管人：中国银行股份有限公司

送出日期：2012 年 3 月 26 日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

基金管理人的董事会及董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。本年度报告已经全部独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2012 年 3 月 20 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书及其更新。

本报告财务资料已经审计，普华永道中天会计师事务所有限公司为本基金出具了无保留意见的审计报告，请投资者注意阅读。

本报告期自 2011 年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

1.2 目录

§1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§2 基金简介	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	5
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况	6
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
3.3 过去三年基金的利润分配情况	9
§4 管理人报告	9
4.1 基金管理人及基金经理情况	9
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	11
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	11
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	11
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	12
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况	13
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	13
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	13
§5 托管人报告	13
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	13
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	14
5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见	14
§6 审计报告	14
6.1 审计报告基本信息	14
6.2 审计报告的基本内容	14
§7 年度财务报表	15
7.1 资产负债表	15
7.2 利润表	16
7.3 所有者权益（基金净值）变动表	17
7.4 报表附注	19
§8 投资组合报告	37
8.1 期末基金资产组合情况	37
8.2 期末按行业分类的股票投资组合	38
8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细	39
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动	48
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	49
8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细	49
8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的所有资产支持证券投资明细	49
8.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细	49

8.9 投资组合报告附注	50
§9 基金份额持有人信息	50
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	50
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金的情况	51
§10 开放式基金份额变动	51
§11 重大事件揭示	51
11.1 基金份额持有人大会决议	51
11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动	51
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	52
11.4 基金投资策略的改变	52
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	52
11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况	52
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	52
11.8 其他重大事件	53
§12 备查文件目录	53
12.1 备查文件目录	53
12.2 存放地点	54
12.3 查阅方式	54

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	泰达宏利中证财富大盘指数证券投资基金
基金简称	泰达宏利财富大盘指数
基金主代码	162213
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2010 年 4 月 23 日
基金管理人	泰达宏利基金管理有限公司
基金托管人	中国银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	472,257,522.45 份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	采用指数化投资策略，紧密跟踪中证财富大盘指数，力争获取与标的指数相似的投资收益，并力争将基金的日跟踪偏离度绝对值控制在 0.35% 以内，年化跟踪误差不超过 4%。
投资策略	本基金采用指数完全复制方法，原则上按照标的指数成份股及其权重的变动进行相应的调整，以达到跟踪和复制指数的目的。但如遇特殊情况（如市场流动性不足、成份股被限制投资等）致使基金无法购得足够数量的股票时，基金管理人将搭配使用其他合理的方法进行适当替代，以使跟踪误差控制在限定范围内。
业绩比较基准	95%×中证财富大盘指数收益率+5%×同业存款利率。
风险收益特征	本基金为股票型指数基金，属于高风险、高收益的基金品种，其预期风险和预期收益高于混合型基金、债券型基金和货币市场基金。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		泰达宏利基金管理有限公司	中国银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	曹桢桢	唐州徽
	联系电话	010-66577728	010-66594855
	电子邮箱	irm@mfcteda.com	tgxxpl@bank-of-china.com
客户服务电话		400-69-88888	95566
传真		010-66577666	010-66594942
注册地址		北京市西城区金融大街 7 号英蓝国际金融中心南楼三层	北京市西城区复兴门内大街 1 号

办公地址	北京市西城区金融大街 7 号 英蓝国际金融中心南楼三层	北京市西城区复兴门内大街 1 号
邮政编码	100033	100818
法定代表人	刘惠文	肖钢

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	中国证券报、上海证券报、证券时报
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	http:// www.mfcteda.com
基金年度报告备置地点	基金管理人、基金托管人的住所

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
会计师事务所	普华永道中天会计师事务所有限公司	上海市黄浦区湖滨路 202 号企业天地 2 号楼普华永道中心 11 楼
注册登记机构	泰达宏利基金管理有限公司	北京市西城区金融大街 7 号英蓝国际 金融中心南楼三层

§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2011 年	2010 年 4 月 23 日 -2010 年 12 月 31 日
本期已实现收益	-35,195,852.42	23,639,221.48
本期利润	-103,021,628.06	850,934.50
加权平均基金份额本期利润	-0.1918	0.0013
本期加权平均净值利润率	-19.25%	0.13%
本期基金份额净值增长率	-18.96%	5.91%
3.1.2 期末数据和指标	2011 年末	2010 年末
期末可供分配利润	-74,708,202.60	23,097,767.96
期末可供分配基金份额利润	-0.1582	0.0388
期末基金资产净值	397,549,319.85	618,841,363.23
期末基金份额净值	0.842	1.039
3.1.3 累计期末指标	2011 年末	2010 年末
基金份额累计净值增长率	-14.17%	5.91%

注：1. 本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益；

2. 所述基金业绩指标不包括基金份额持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要

低于所列数字；

3. 期末可供分配利润等于期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数；

4. 本基金基金合同于 2010 年 4 月 23 日生效。比较指标的实际编制期间为 2010 年 4 月 23 日（基金合同生效日）至 2010 年 12 月 31 日。

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

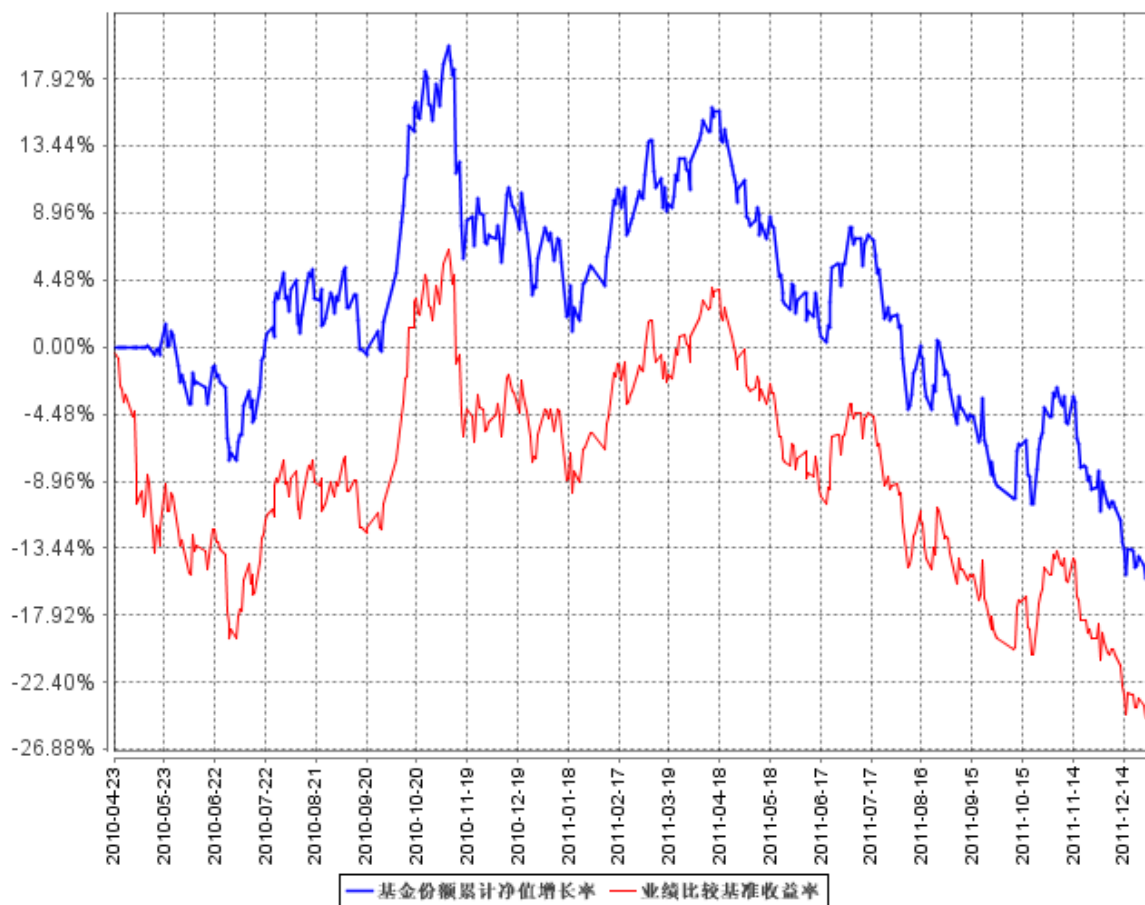
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去三个月	-5.39%	1.25%	-5.27%	1.25%	-0.12%	0.00%
过去六个月	-18.65%	1.25%	-18.83%	1.25%	0.18%	0.00%
过去一年	-18.96%	1.20%	-18.87%	1.20%	-0.09%	0.00%
自基金合同生效起至今	-14.17%	1.25%	-23.66%	1.36%	9.49%	-0.11%

注：本基金业绩比较基准： $95\% \times \text{中证财富大盘指数收益率} + 5\% \times \text{同业存款利率}$ 。

本基金股票资产的跟踪标的指数为中证财富大盘指数。中证财富大盘指数是由中证指数有限公司编制并开发的中国 A 股市场指数。该指数按照上市公司创造财富能力的大小进行选择，挑选最具创造财富能力的 300 家 A 股上市公司作为样本；此外该指数在加权方式上亦有所创新，不同于一般的市值加权指数，该指数样本个股的权重配置将与其创造财富能力的大小相适应，从而打破市值指数中价格与权重过于紧密的联系，预防个股权重由于价格的非理性波动而大起大落，提高了个股权重配置的稳定性。指数的表现综合反映了中国经济增长过程中核心企业真实的财富增长情况。

3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

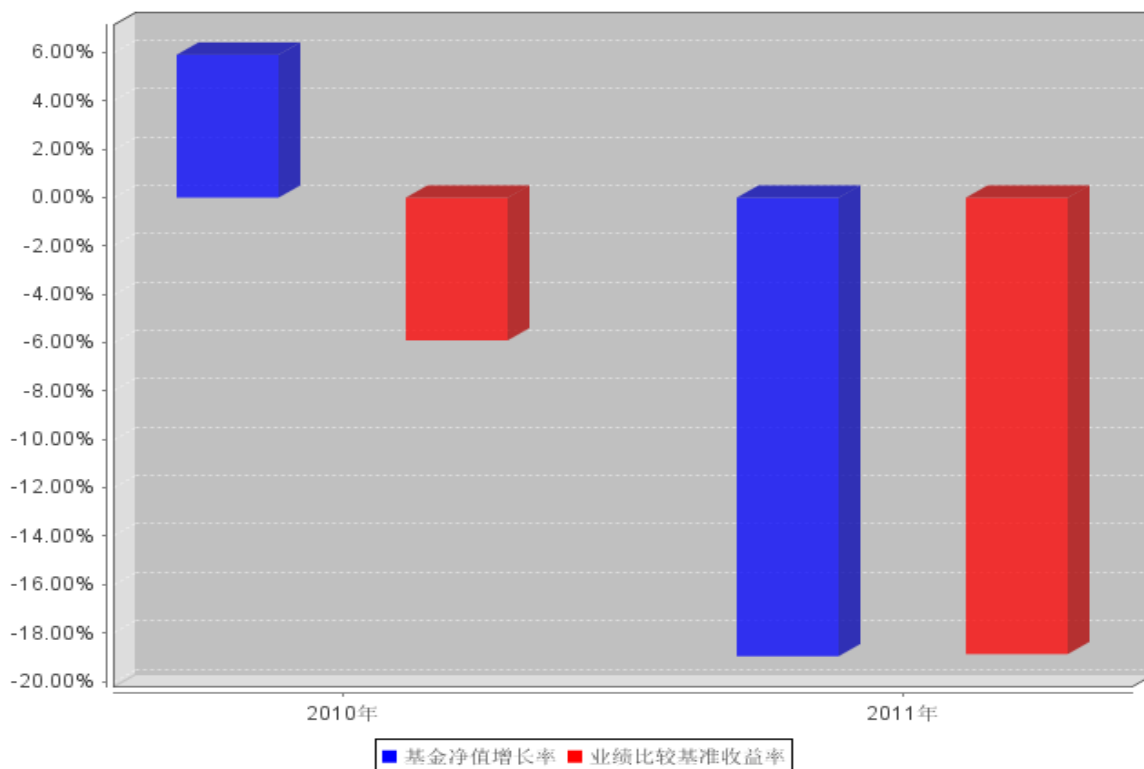
基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：本基金在建仓结束时及本报告期末本基金的投资比例已达到基金合同规定的各项投资比例。

3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的对比图



注：本基金合同生效日为 2010 年 4 月 23 日，2010 年度净值增长率的计算期间为 2010 年 4 月 23 日至 2010 年 12 月 31 日。

3.3 过去三年基金的利润分配情况

单位：人民币元

年度	每10份基金份额 分红数	现金形式发放 总额	再投资形式发 放总额	年度利润分配合 计	备注
2011	-	-	-	-	
2010	0.2000	6,627,393.10	414,809.50	7,042,202.60	
合计	0.2000	6,627,393.10	414,809.50	7,042,202.60	

注：本基金基金合同于 2010 年 4 月 23 日生效。2010 年的利润分配情况实际编制期间为 2010 年 4 月 23 日（基金合同生效日）至 2010 年 12 月 31 日。

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

泰达宏利基金管理有限公司原名湘财合丰基金管理有限公司、湘财荷银基金管理有限公司、泰达

荷银基金管理有限公司，成立于 2002 年 6 月，是中国首批合资基金管理公司之一。截至报告期末本公司股东及持股比例分别为：北方国际信托股份有限公司：51%；宏利资产管理（香港）有限公司：49%。

目前公司管理着包括泰达宏利价值优化型系列基金、泰达宏利行业精选基金、泰达宏利风险预算混合型基金、泰达宏利货币市场基金、泰达宏利效率优选混合型基金、泰达宏利首选企业股票型基金、泰达宏利市值优选股票型基金、泰达宏利集利债券型基金、泰达宏利品质生活灵活配置混合型基金、泰达宏利红利先锋股票型基金、泰达宏利中证财富大盘指数型基金、泰达宏利领先中小盘股票型基金、泰达宏利聚利分级债券型基金、泰达宏利全球新格局基金(QDII-FOF)、泰达宏利中证 500 指数分级基金在内的十七只证券投资基金。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
王咏辉	本基金基金经理	2010 年 4 月 23 日	-	14	英国牛津大学工程和计算机专业，硕士学历；曾担任伦敦摩根大通（JP Morgan）投资基金管理公司分析员、高级分析师、汇丰投资基金管理公司（HSBC）高级分析师、巴克莱国际投资基金管理公司 ETF 亚洲部门经理、巴克莱资本公司（Barclays Capital）部门经理。2008 年 4 月加入泰达宏利基金管理有限公司，担任金融工程部副总经理；2011 年 7 月 20 日起担任泰达宏利全球新格局证券投资基金基金经理；2011 年 12 月 1 日起任泰达宏利中证 500 指数分级基金基金经理；具备 14 年基金从业经验，具有基金从业资格。

注：证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。表中的任职日期和

离任日期均指公司做出决定的公告日期。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守《证券法》、《证券投资基金法》、本基金合同和其他有关法律法规的规定，在基金管理运作中，本基金的投资范围、投资比例、投资组合、证券交易行为、信息披露等符合有关法律法规、行业监管规则和基金合同等规定，本基金没有发生重大违法违规行为，没有运用基金财产进行内幕交易和操纵市场行为以及进行有损基金投资人利益的关联交易，整体运作合法、合规。本基金将继续一如既往地本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金财产，在规范基金运作和严格控制投资风险的前提下，努力为基金份额持有人谋求最大利益。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

本基金管理人建立了公平交易制度和流程，并严格执行制度的规定。在投资管理活动中，本基金管理人公平对待不同投资组合，确保各投资组合在获得投资信息、投资建议和投资决策方面享有平等机会；严格执行投资管理职能和交易执行职能的隔离；在交易环节实行集中交易制度，并确保公平交易可操作、可评估、可稽核、可持续；交易部运用交易系统中设置的公平交易功能并按照时间优先，价格优先的原则严格执行所有指令，未发生任何利益输送的情况。

4.3.2 本投资组合与其他投资风格相似的投资组合之间的业绩比较

本基金与公司管理的其他投资组合不具有相似的投资风格。

4.3.3 异常交易行为的专项说明

本基金管理人建立了对异常交易的控制制度，在本报告期内未发生因异常交易而受到监管机构处罚的情况。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

A 股市场 2011 年基本上呈震荡下跌的走势，同时 CPI 在季节性规律和政府的主动调控政策下出现了放缓。2011 年全年引发市场分化下跌的主要因素有几个方面，一是通胀见顶后政策放松没有到预期，二是国内经济大幅下滑的预期加强，三是欧洲债务危机引发的金融危机。

本基金在 2011 年利用深度的数量化研究和跟踪误差准确控制能力，同时通过有效的主动式数量化投资技术增加了表现不错的股票配置权重。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截止报告期末，本基金份额净值为 0.842 元，本报告期份额净值增长率为-18.96%，同期业绩比较基准增长率为-18.87%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

无论是从宏观经济指标还是政策的进度看，当前的宏观运行以及相关指标非常接近于 08 年 7、8 月份，处于一系列严厉紧缩政策的调控效果充分释放期，但是还没有出现可能导致政策显著逆转的冲击性事件，政策还处于调控效果的观察期。未来宏观政策是否明显转变取决于几个大的不确定性因素：

1. 外部会不会出现希腊违约这种类似雷曼倒闭这样的信用事件；
2. 房地产市场是否可能出现急跌式的明显调整，导致投资增速显著下滑；
3. 外贸增长回落。目前比较一致的看法是明年出口增长 15%，如果外部恶化，可能触发政策转换。

总体看，目前政策的总体基调是以政策平稳为主，与美国、德国和法国等主要经济面临的挑战一样，在政府换届之前如果没有大幅内部或外部冲击，一般不会出现大幅政策刺激和调整。

欧洲债务危机是国内外金融市场最近关心的问题，目前来看，欧洲问题的前景已经明朗，决定因素超出了经济范畴。对于欧洲来讲，需要平衡两个矛盾：

第一，通过进一步的统一财政联盟来解决统一的货币政策与不统一的财政政策的结合之间的矛盾，但是欧洲富国的财富必须转移支付给欧洲穷国；

第二，剔除欧洲穷国欧元区缩小，但是具体运作时，存在政治和成本上的难度。

总之，解决办法无外乎有一种：短期 1-6 个月通过 IMF 或 ECB 维持欧洲国债收益率，长期 1-2 年逐步实现统一财政联盟，并且整个欧元区的 EURUSD 贬值，从而实现欧洲穷国可以依靠出口拉动经济复苏。

财富大盘指数是中国市场的价值风向标。投资策略方面，短期较为看好大盘股、低价股、低估值和高红利的股票，以创业板为代表的高估值品种面临较大的回归压力，扩容节奏的加快，尤其是新三板的推出将加速创业板泡沫的破灭。大盘蓝筹股风险释放充分，将对稳定市场发挥一定作用。调整充分的房地产股也存在估值修复的机会。

在具体行业配置上，我认为今年行业配置的重要性显著提高，重点配置行业：1、随着通胀见顶、政策担忧减缓，逐步加仓低估值和周期的金融、地产、水泥等板块；2、继续看好银行、煤炭、建筑建材、工程机械等先进制造业。

4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

在本报告期内，基金管理人为防范和化解经营风险，确保基金投资的合法合规、切实维护基金份额持有人的最大利益，基金管理人主要采取了如下监察稽核措施：本基金管理人根据《证券投资基金法》等相关法律、法规、规章和公司管理制度，督察长、监察稽核部门、风险控制部门定期与不定期的对基金的投资、交易、研发、市场销售、信息披露等方面进行事前、事中或事后的监督检查。

同时，公司制定了具体严格的投资授权流程与权限；在证券投资交易前由研究部门建立可供投资的优选库并定期进行全面维护更新和适时对个股进行维护更新，通过信息技术建立多级投资交易预警系统，并把禁选股票排除在交易系统之外；设立专人负责信息披露工作，信息披露做到真实、准确、完整、及时；引入外方股东在风险控制方面的先进经验，完善公司风险管理指标及流程，监控公司各项业务的运作状况和风险程度；独立于各业务部门的内部监察人员日常对公司经营、基金运作及员工行为的合规性进行定期和不定期检查，发现问题及时督促有关部门整改，并定期制作监察稽核报告报中国证监会、当地证监局和公司董事会。

4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人按照相关法律法规规定，设有估值委员会，并制定了相关制度及流程。估值委员会主要负责基金估值相关工作的评估、决策、执行和监督，确保基金估值的公允与合理。报告期内相关基金估值政策由托管银行进行复核。公司估值委员会由主管运营的副总经理负责，成员包括督察长、投资总监、基金经理及研究部、交易部、固定收益部、监察稽核部、金融工程部、风险管理部、基金运营部的相关人员，均具有丰富的专业工作经历，具备良好的专业经验和专业胜任能力。

基金经理参与估值委员会对相关停牌品种估值的讨论，发表相关意见和建议，但涉及停牌品种的基金经理不参与最终的投票表决。本公司参与估值流程各方之间没有存在任何重大利益冲突，一切以投资者利益最大化为最高准则。

4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据本基金基金合同及基金的实际运作情况，本基金于本报告期内未进行利润分配，目前无其他收益分配安排。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，中国银行股份有限公司（以下称“本托管人”）在对泰达宏利财富大盘指数证券投

资基金（以下称“本基金”）的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了应尽的义务。

5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期内，本托管人根据《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，对本基金管理人的投资运作进行了必要的监督，对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真地复核，未发现本基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告（注：财务会计报告中的“金融工具风险及管理”部分未在托管人复核范围内）、投资组合报告等数据真实、准确和完整。

§ 6 审计报告

6.1 审计报告基本信息

财务报表是否经过审计	是
审计意见类型	标准无保留意见
审计报告编号	普华永道中天审字(2011)第 20404 号

6.2 审计报告的基本内容

审计报告标题	审计报告
审计报告收件人	泰达宏利中证财富大盘指数证券投资基金全体基金份额持有人
引言段	我们审计了后附的泰达宏利中证财富大盘指数证券投资基金(以下简称“泰达宏利财富大盘基金”)的财务报表,包括 2011 年 12 月 31 日的资产负债表、2011 年度的利润表和所有者权益(基金净值)变动表以及财务报表附注。
管理层对财务报表的责任段	编制和公允列报财务报表是泰达宏利财富大盘基金的基金管理人泰达宏利基金管理有限公司管理层的责任。这种责任包括: (1) 按照企业会计准则和中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制财务报表,并使其实现公允反映; (2) 设计、执行和维护必要的内部控制,以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。
注册会计师的责任段	我们的责任是在执行审计工作的基础上对财务报表发表审计意见。

	<p>我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。中国注册会计师审计准则要求我们遵守中国注册会计师职业道德守则，计划和执行审计工作以对财务报表是否不存在重大错报获取合理保证。</p> <p>审计工作涉及实施审计程序，以获取有关财务报表金额和披露的审计证据。选择的审计程序取决于注册会计师的判断，包括对由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险的评估。在进行风险评估时，注册会计师考虑与财务报表编制和公允列报相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。审计工作还包括评价管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计的合理性，以及评价财务报表的总体列报。</p> <p>我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。</p>
审计意见段	<p>我们认为，上述泰达宏利财富大盘基金的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则和在财务报表附注中所列示的中国证监会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制，公允反映了泰达宏利财富大盘基金 2011 年 12 月 31 日的财务状况以及 2011 年度的经营成果和基金净值变动情况。</p>
注册会计师的姓名	汪棣 单峰
会计师事务所的名称	普华永道中天会计师事务所有限公司
会计师事务所的地址	中国上海市黄浦区湖滨路 202 号企业天地 2 号楼普华永道中心 11 楼
审计报告日期	2012 年 3 月 23 日

§ 7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：泰达宏利中证财富大盘指数证券投资基金

报告截止日：2011 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2011 年 12 月 31 日	上年度末 2010 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	7.4.7.1	21,626,092.81	24,905,028.75
结算备付金		136,974.45	6,805,064.71
存出保证金		299,850.47	630,219.46
交易性金融资产	7.4.7.2	376,385,573.24	589,591,595.75
其中：股票投资		376,385,573.24	589,500,657.15
基金投资		-	-
债券投资		-	90,938.60

资产支持证券投资		-	-
衍生金融资产	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-	-
应收证券清算款		186,048.81	-
应收利息	7.4.7.5	4,312.43	23,635.58
应收股利		-	-
应收申购款		31,155.56	52,310.64
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	-	-
资产总计		398,670,007.77	622,007,854.89
负债和所有者权益	附注号	本期末 2011年12月31日	上年度末 2010年12月31日
负 债:			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		-	-
应付赎回款		16,443.20	172,681.62
应付管理人报酬		223,637.44	366,352.31
应付托管费		41,286.92	67,634.29
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	7.4.7.7	175,329.42	1,914,750.59
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.8	663,990.94	645,072.85
负债合计		1,120,687.92	3,166,491.66
所有者权益:			
实收基金	7.4.7.9	472,257,522.45	595,743,595.27
未分配利润	7.4.7.10	-74,708,202.60	23,097,767.96
所有者权益合计		397,549,319.85	618,841,363.23
负债和所有者权益总计		398,670,007.77	622,007,854.89

注：报告截止日 2011 年 12 月 31 日，基金份额净值 0.842 元，基金份额总额 472,257,522.45 份。

7.2 利润表

会计主体：泰达宏利中证财富大盘指数证券投资基金

本报告期：2011 年 1 月 1 日至 2011 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2011 年 1 月 1 日至 2011 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2010 年 4 月 23 日至 2010 年 12 月 31 日
一、收入		-96,211,812.63	11,542,955.70
1.利息收入		235,956.99	1,533,394.28
其中：存款利息收入	7.4.7.11	235,167.09	695,499.20
债券利息收入		789.90	227.19
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	837,667.89
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		-29,037,812.91	30,917,794.90
其中：股票投资收益	7.4.7.12	-36,677,254.01	25,165,574.94
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.13	30,074.39	51,039.05
资产支持证券投资收益		-	-
衍生工具收益	7.4.7.14	-	-
股利收益	7.4.7.15	7,609,366.71	5,701,180.91
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.16	-67,825,775.64	-22,788,286.98
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.17	415,818.93	1,880,053.50
二、费用		6,809,815.43	10,692,021.20
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	3,489,893.88	2,950,781.13
2. 托管费	7.4.10.2.2	644,288.14	544,759.61
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	7.4.7.18	2,149,938.58	6,773,311.64
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 其他费用	7.4.7.19	525,694.83	423,168.82
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-103,021,628.06	850,934.50
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-103,021,628.06	850,934.50

注：比较财务报表的比较期间为 2010 年 4 月 23 日（基金合同生效日）至 2010 年 12 月 31 日。

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：泰达宏利中证财富大盘指数证券投资基金

本报告期：2011 年 1 月 1 日至 2011 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2011 年 1 月 1 日至 2011 年 12 月 31 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	595,743,595.27	23,097,767.96	618,841,363.23
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-103,021,628.06	-103,021,628.06
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	-123,486,072.82	5,215,657.50	-118,270,415.32
其中：1. 基金申购款	242,231,750.19	8,334,121.12	250,565,871.31
2. 基金赎回款	-365,717,823.01	-3,118,463.62	-368,836,286.63
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-
五、期末所有者权益（基金净值）	472,257,522.45	-74,708,202.60	397,549,319.85
项目	上年度可比期间 2010 年 4 月 23 日至 2010 年 12 月 31 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	1,165,158,636.81	-	1,165,158,636.81
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	850,934.50	850,934.50
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	-569,415,041.54	29,289,036.06	-540,126,005.48
其中：1. 基金申购款	860,948,725.13	102,956,706.14	963,905,431.27
2. 基金赎回款	-1,430,363,766.67	-73,667,670.08	-1,504,031,436.75
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-7,042,202.60	-7,042,202.60
五、期末所有者权益（基金净值）	595,743,595.27	23,097,767.96	618,841,363.23

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 财务报表由下列负责人签署：

<u>缪钧伟</u>	<u>傅国庆</u>	<u>王泉</u>
基金管理公司负责人	主管会计工作负责人	会计机构负责人

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

泰达宏利中证财富大盘指数证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可【2010】第 176 号《关于核准泰达宏利中证财富大盘指数证券投资基金募集的批复》核准,由泰达宏利基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《泰达宏利中证财富大盘指数证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式,存续期限不定,首次设立募集不包括认购资金利息共募集 1,165,036,951.93 元,业经普华永道中天会计师事务所有限公司普华永道中天验字(2010)第 092 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《泰达宏利中证财富大盘指数证券投资基金基金合同》于 2010 年 4 月 23 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 1,165,158,636.81 份基金份额,其中认购资金利息折合 121,684.88 份基金份额。本基金的基金管理人为泰达宏利基金管理有限公司,基金托管人为中国银行股份有限公司(以下简称“中国银行”)。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《泰达宏利中证财富大盘指数证券投资基金基金合同》的有关规定,本基金的投资目标是紧密跟踪中证财富大盘指数,力争获取与标的指数相似的投资收益,并力争将基金的日跟踪偏离度绝对值控制在 0.35%以内,年化跟踪误差不超过 4%;本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具,包括国内依法发行上市的股票、债券、货币市场工具、权证及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具。其中投资于股票组合的比例不低于基金资产的 90%,投资组合中投资于中证财富大盘指数成份股的资产不低于股票资产的 90%,现金及到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%。本基金的业绩比较基准为: 中证财富大盘指数收益率×95%+同业存款利率×5%。

本财务报表由本基金的基金管理人泰达宏利基金管理有限公司于 2012 年 3 月 26 日批准报出。

7.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日颁布的《企业会计准则—基本准则》和 38 项具体会计准则、其后颁布的企业会计准则应用指南、企业会计准则解释以及其他相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会公告[2010]5 号《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和半年度报告>》、中国证券业协会于 2007 年 5 月 15 日颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《泰达宏利中证财富大盘指数证券投资基金基金合同》和在财务报表附注 7.4.4 所列示的中国证监会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金 2011 年 12 月 31 日的财务状况以及 2011 年度的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

7.4.4 重要会计政策和会计估计

7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。比较财务报表的实际编制期间为 2010 年 4 月 23 日(基金合同生效日)至 2010 年 12 月 31 日止。

7.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

(1) 金融资产的分类

金融资产于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、应收款项、可供出售金融资产及持有至到期投资。金融资产的分类取决于本基金对金融资产的持有意图和持有能力。本基金现无金融资产分类为可供出售金融资产及持有至到期投资。

本基金持有的股票投资、债券投资和衍生工具(主要为权证投资)分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。除衍生工具所产生的金融资产在资产负债表中以衍生金融资产列示外，以公允价值计量且其公允价值变动计入损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。

本基金持有的其他金融资产分类为应收款项，包括银行存款和各类应收款项等。应收款项是指在活跃市场中没有报价、回收金额固定或可确定的非衍生金融资产。

(2) 金融负债的分类

金融负债于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债及其他金融负债。本基金目前暂无分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金持有的其他金融负债包括卖出回购金融资产款和各类应付款项等。

7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产或金融负债于本基金成为金融工具合同的一方时，于交易日按公允价值在资产负债表内确认。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，取得时发生的相关交易费用计入当期损益；对于支付的价款中包含已宣告但尚未发放的现金股利或债券起息日或上次除息日至购买日止的利息，单独确认为应收项目。应收款项和其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产按照公允价值进行后续计量；对于应收款

项和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量。

当收取某项金融资产现金流量的合同权利已终止或该金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬已转移时，终止确认该金融资产。终止确认的金融资产的成本按移动加权平均法于交易日结转。

7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的股票投资、债券投资和衍生工具(主要为权证投资)按如下原则确定公允价值并进行估值：

(1) 存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值；估值日无交易，但最近交易日后经济环境未发生重大变化且证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。

(2) 存在活跃市场的金融工具，如估值日无交易且最近交易日后经济环境发生了重大变化，参考类似投资品种的现行市价及重大变化等因素，调整最近交易市价以确定公允价值。

(3) 当金融工具不存在活跃市场，采用市场参与者普遍认同且被以往市场实际交易价格验证具有可靠性的估值技术确定公允价值。估值技术包括参考熟悉情况并自愿交易的各方最近进行的市场交易中使用的价格、参照实质上相同的其他金融工具的当前公允价值、现金流量折现法和期权定价模型等。采用估值技术时，尽可能最大程度使用市场参数，减少使用与本基金特定相关的参数。

7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

本基金持有的资产和承担的负债基本为金融资产和金融负债。当本基金依法有权抵销债权债务且交易双方准备按净额结算时，金融资产与金融负债按抵销后的净额在资产负债表中列示。

7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

7.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现平准金和未实现平准金。已实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占基金净值比例计算的金额。未实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现损益占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列，并于期末全额转入未分配利润。

7.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认为投资收益。债券投资在持有期间应取得的按票面利率计算的利息扣除在适用情况下由债券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认为利息收入。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动确认为公允价值变动损益；处置时其公允价值与初始确认金额之间的差额确认为投资收益，其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

应收款项在持有期间确认的利息收入按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

7.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬和托管费在费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计算方法逐日确认。

其他金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

7.4.4.11 基金的收益分配政策

每一基金份额享有同等分配权。本基金收益以现金形式分配，但基金份额持有人可选择现金红利或将现金红利按分红除权日基金份额净值自动转为基金份额进行再投资。若期末未分配利润中的未实现部分(包括基金经营活动产生的未实现损益以及基金份额交易产生的未实现平准金等)为正数，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润中的已实现部分；若期末未分配利润的未实现部分为负数，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润(已实现部分相抵未实现部分后的余额)。

经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从所有者权益转出。

7.4.4.12 分部报告

本基金以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部，以经营分部为基础确定报告分部并披露分部信息。经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分：(1) 该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用；(2) 本基金管理人能够定期评价该组成部分的经营成果，以决定向其配置资源、评价其业绩；(3) 本基金能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征，并且满足一定条件的，则合并为一个经营分部。

本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要进行分部报告的披露。

7.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

根据本基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作，本基金确定以下类别股票投资和债券投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：

(a) 对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌或交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)等情况，本基金根据中国证监会公告[2008]38号《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》，根据具体情况采用《中国证券业协会基金估值工作小组关于停牌股票估值的参考方法》提供的指数收益法、市盈率法、现金流量折现法等估值技术进行估值。

(b) 对于在锁定期内的非公开发行股票，根据中国证监会基金部通知[2006]37号《关于加强基金投资非公开发行股票风险控制有关问题的通知》，若在证券交易所挂牌的同一股票的市场交易收盘价低于非公开发行股票的初始投资成本，按估值日证券交易所挂牌的同一股票的市场交易收盘价估值；若在证券交易所挂牌的同一股票的市场交易收盘价高于非公开发行股票的初始投资成本，按锁定期内已经过交易天数占锁定期内总交易天数的比例将两者之间差价的一部分确认为估值增值。

(c) 在银行间同业市场交易的债券品种，根据中国证监会证监会计字[2007]21号《关于证券投资基金执行〈企业会计准则〉估值业务及份额净值计价有关事项的通知》采用估值技术确定公允价值。本基金持有的银行间同业市场债券按现金流量折现法估值，具体估值模型、参数及结果由中央国债登记结算有限责任公司独立提供。

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期内无会计政策变更。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无会计估计变更。

7.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期无差错更正。

7.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2004]78号《关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[2005]102号《关于股息红利个人所得税有关政策的通知》、财税[2005]107号《关于股息红利有关个人所得税政策的补充通知》、财税[2008]11号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 以发行基金方式募集资金不属于营业税征收范围，不征收营业税。

(2) 基金买卖股票、债券的差价收入暂免征营业税和企业所得税。

(3) 对基金取得的企业债券利息收入，由发行债券的企业在向基金派发利息时代扣代缴 20% 的个人所得税，暂不征收企业所得税。对基金取得的股票的股息、红利收入，由上市公司在向基金派发股息、红利时暂减按 50% 计入个人应纳税所得额，依照现行税法规定即 20% 代扣代缴个人所得税，暂不征收企业所得税。

(4) 基金卖出股票按 0.1% 的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。

7.4.7 重要财务报表项目的说明

7.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2011 年 12 月 31 日		上年度末 2010 年 12 月 31 日	
	活期存款	21,626,092.81		24,905,028.75
定期存款	-		-	
其中：存款期限 1-3 个月	-		-	
其他存款	-		-	
合计：	21,626,092.81		24,905,028.75	

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2011 年 12 月 31 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	466,999,635.86	376,385,573.24	-90,614,062.62
债券	交易所市场	-	-
	银行间市场	-	-
	合计	-	-
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	466,999,635.86	376,385,573.24	-90,614,062.62
项目	上年度末 2010 年 12 月 31 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	612,305,882.73	589,500,657.15	-22,805,225.58
债券	交易所市场	74,000.00	90,938.60
	银行间市场	-	-
	合计	74,000.00	90,938.60

资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	612,379,882.73	589,591,595.75	-22,788,286.98

注：截至本报告期末 2011 年 12 月 31 日止，本基金股票投资余额中无按照指数收益法估值的情况，本基金也未投资银行间债券。

7.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末未持有衍生金融资产/负债（2010 年末同）。

7.4.7.4 买入返售金融资产

7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末买入返售金融资产余额为零（2010 年同）。

7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末未持有买断式逆回购交易中取得的债券（2010 年同）。

7.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2011 年 12 月 31 日	上年度末 2010 年 12 月 31 日
应收活期存款利息	4,250.47	8,205.02
应收定期存款利息	-	-
应收其他存款利息	-	-
应收结算备付金利息	61.70	2,381.70
应收债券利息	-	36.01
应收买入返售证券利息	-	-
应收申购款利息	0.26	13,012.85
其他	-	-
合计	4,312.43	23,635.58

7.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末其他资产余额为零。（2010 年同）

7.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2011 年 12 月 31 日	上年度末 2010 年 12 月 31 日
交易所市场应付交易费用	175,329.42	1,914,750.59

银行间市场应付交易费用	-	-
合计	175,329.42	1,914,750.59

7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2011 年 12 月 31 日	上年度末 2010 年 12 月 31 日
应付券商交易单元保证金	250,000.00	250,000.00
应付赎回费	77.56	947.60
预提费用	390,000.00	303,332.00
指数使用费	23,913.38	90,793.25
合计	663,990.94	645,072.85

7.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2011 年 1 月 1 日至 2011 年 12 月 31 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	595,743,595.27	595,743,595.27
本期申购	242,231,750.19	242,231,750.19
本期赎回(以“-”号填列)	-365,717,823.01	-365,717,823.01
本期末	472,257,522.45	472,257,522.45

注：申购含红利再投、转换入份额；赎回含转换出份额。

7.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	30,168,486.24	-7,070,718.28	23,097,767.96
本期利润	-35,195,852.42	-67,825,775.64	-103,021,628.06
本期基金份额交易产生的变动数	-2,207,339.29	7,422,996.79	5,215,657.50
其中：基金申购款	9,178,144.84	-844,023.72	8,334,121.12
基金赎回款	-11,385,484.13	8,267,020.51	-3,118,463.62
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-7,234,705.47	-67,473,497.13	-74,708,202.60

7.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2011 年 1 月 1 日至 2011 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2010 年 4 月 23 日至 2010 年 12 月 31 日
活期存款利息收入	220,199.91	642,322.56
定期存款利息收入	-	-
其他存款利息收入	-	-
结算备付金利息收入	11,571.01	37,959.80
其他	3,396.17	15,216.84
合计	235,167.09	695,499.20

7.4.7.12 股票投资收益

7.4.7.12.1 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2011 年 1 月 1 日至 2011 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2010 年 4 月 23 日至 2010 年 12 月 31 日
卖出股票成交总额	734,599,951.41	2,012,327,689.01
减：卖出股票成本总额	771,277,205.42	1,987,162,114.07
买卖股票差价收入	-36,677,254.01	25,165,574.94

7.4.7.13 债券投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2011 年 1 月 1 日至 2011 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2010 年 4 月 23 日至 2010 年 12 月 31 日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	530,075.30	485,530.23
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	499,173.53	434,300.00
减：应收利息总额	827.38	191.18
债券投资收益	30,074.39	51,039.05

7.4.7.14 衍生工具收益

本基金本报告期内无买卖权证差价收入(2010 年同)。

7.4.7.15 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2011 年 1 月 1 日至 2011 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2010 年 4 月 23 日至 2010 年 12 月 31 日
股票投资产生的股利收益	7,609,366.71	5,701,180.91
基金投资产生的股利收益	-	-
合计	7,609,366.71	5,701,180.91

7.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2011 年 1 月 1 日至 2011 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2010 年 4 月 23 日至 2010 年 12 月 31 日
1. 交易性金融资产	-67,825,775.64	-22,788,286.98
——股票投资	-67,808,837.04	-22,805,225.58
——债券投资	-16,938.60	16,938.60
——资产支持证券投资	-	-
2. 衍生工具	-	-
——权证投资	-	-
3. 其他	-	-
合计	-67,825,775.64	-22,788,286.98

7.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2011 年 1 月 1 日至 2011 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2010 年 4 月 23 日至 2010 年 12 月 31 日
基金赎回费收入	276,987.88	1,519,611.73
转换费收入	138,831.05	360,441.77
合计	415,818.93	1,880,053.50

注：1. 本基金的赎回费率按持有期间递减，赎回费总额的 25% 归入基金资产。

2. 本基金的转换费由转出基金赎回费用及基金申购补差费用构成，其中赎回费用的 25% 的部分归入基金资产。

7.4.7.18 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2011 年 1 月 1 日至 2011 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2010 年 4 月 23 日至 2010 年 12 月 31 日
交易所市场交易费用	2,149,938.58	6,773,311.64

银行间市场交易费用	-	-
合计	2,149,938.58	6,773,311.64

7.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2011年1月1日至2011年12月31日	上年度可比期间 2010年4月23日至2010年12月31日
审计费用	90,000.00	90,000.00
信息披露费	300,000.00	213,332.00
银行费用	10,313.51	20,643.57
银行间账户维护费	18,000.00	7,500.00
指数使用费	107,381.32	90,793.25
其他	-	900.00
合计	525,694.83	423,168.82

注：指数使用费为支付标的指数供应商的标的指数许可使用费，按前一日基金资产净值的 0.02% 的年费率计提，逐日累计，标的指数许可使用费的收取下限为每季度（自然季度）人民币 50,000 元。该下限超出当季累计指数使用费的部分由基金管理人自行承担，不作为基金费用从基金财产中列支。

7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

7.4.8.1 或有事项

本基金本报告期无或有事项。

7.4.8.2 资产负债表日后事项

本基金本报告期无资产负债表日后事项。

7.4.9 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
泰达宏利基金管理有限公司	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
中国银行股份有限公司（“中国银行”）	基金托管人、基金代销机构
北方国际信托股份有限公司	基金管理人的股东
宏利资产管理(香港)有限公司	基金管理人的股东

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.10.1.1 股票交易

本基金在本报告期内无通过关联交易单元进行的股票交易(2010年同)。

7.4.10.1.2 债券交易

本基金本报告期内无通过关联交易单元进行的债券交易(2010 年同)。

7.4.10.1.3 债券回购交易

本基金本报告期内无通过关联交易单元进行的债券回购交易(2010 年同)。

7.4.10.1.4 权证交易

本基金本报告期内无通过关联交易单元进行的权证交易(2010 年同)。

7.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

本基金本报告期内无应支付关联方的佣金(2010 年同)。

7.4.10.2 关联方报酬

7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2011 年 1 月 1 日至 2011 年 12 月 31 日	2010 年 4 月 23 日至 2010 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的管理费	3,489,893.88	2,950,781.13
其中：支付销售机构的客户维护费	188,214.39	362,790.05

注：支付基金管理人泰达宏利基金管理有限公司的管理人报酬按前一日基金资产净值 0.65%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：日管理人报酬=前一日基金资产净值×0.65% / 当年天数。

7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2011 年 1 月 1 日至 2011 年 12 月 31 日	2010 年 4 月 23 日至 2010 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的托管费	644,288.14	544,759.61

注：支付基金托管人中国银行的托管费按前一日基金资产净值 0.12%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：日托管费=前一日基金资产净值×0.12% / 当年天数。

7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期内无与关联方进行银行间同业市场债券（含回购）的交易(2010 年同)。

7.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

7.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本基金本报告期内无基金管理人运用固有资金投资本基金的情况(2010 年同)。

7.4.10.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

本基金本报告期末无除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况(2010 年同)。

7.4.10.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期		上年度可比期间	
	2011 年 1 月 1 日至 2011 年 12 月 31 日		2010 年 4 月 23 日至 2010 年 12 月 31 日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国银行	21,626,092.81	220,199.91	24,905,028.75	642,322.56

注：本基金的银行存款由基金托管人中国银行保管，按银行同业利率计息。

7.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期内无在承销期内参与关联方承销证券的情况(2010 年同)。

7.4.10.7 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期内无其他关联交易事项(2010 年同)。

7.4.11 利润分配情况

7.4.11.1 利润分配情况——非货币市场基金

本基金本报告期末进行利润分配。

7.4.12 期末（2011 年 12 月 31 日）本基金持有的流通受限证券

7.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

本基金本报告期末未持有因认购新发/增发证券而流通受限的证券。

7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量(股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
600820	隧道股份	2011 年 12 月 27 日	并购重组审核	7.87	2012 年 1 月 4 日	8.15	56,493	620,097.51	444,599.91	-
000768	西飞国际	2011 年 12 月 28 日	并购重组审核	7.26	2012 年 1 月 4 日	7.61	45,217	527,702.17	328,275.42	-
600963	岳阳林	2011 年 12 月	重大事项公	4.68	2012 年 1 月 4 日	4.92	50,844	497,521.16	237,949.92	-

纸	27 日	告							
---	------	---	--	--	--	--	--	--	--

注：本基金截至 2011 年 12 月 31 日止持有以上因公布的重大事项可能产生重大影响而被暂时停牌的股票，该类股票将在所公布事项的重大影响消除后，经交易所批准复牌。

7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

本基金本报告期末无银行间市场债券正回购余额。

7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末无交易所市场债券正回购余额。

7.4.13 金融工具风险及管理

本基金是一只股票型指数投资基金，属于高风险品种。本基金投资的金融工具主要包括股票投资、债券投资、货币市场工具投资、权证投资及资产支持证券投资等。本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是争取将以上风险控制在限定的范围之内，使本基金在风险和收益之间取得最佳的平衡以实现“风险和收益相匹配”的风险收益目标。

7.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金的基金管理人奉行全面风险管理体系的建设，建立了以风险控制委员会为核心的、由督察长、风险控制委员会、监察稽核部和相关业务部门构成的风险管理架构体系。本基金的基金管理人在董事会下设立风险管理委员会，负责制定风险管理的宏观政策，审议通过风险控制的总体措施等；在管理层层面设立风险控制委员会，讨论和制定公司日常经营过程中风险防范和控制措施；在业务操作层面风险管理职责主要由监察稽核部负责，协调并与各部门合作完成运作风险管理以及进行投资风险分析与绩效评估。监察稽核部对公司执行总裁负责，并由督察长分管。

本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理方法主要是通过定性分析和定量分析的方法去估测各种风险产生的可能损失。从定性分析的角度出发，判断风险损失的严重程度和出现同类风险损失的频度。而从定量分析的角度出发，根据本基金的投资目标，结合基金资产所运用金融工具特征通过特定的风险量化指标、模型，日常的量化报告，确定风险损失的限度和相应置信程度，及时可靠地对各种风险进行监督、检查和评估，并通过相应决策，将风险控制在可承受的范围内。

7.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息等情况，导致基金资产损失和收益变化的风险。

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的银行存款存放在本基金的托管行中国银行，与该银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约风险可能性很小；在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，通过对投资品种信用等级评估来控制证券发行人的信用风险，且通过分散化投资以分散信用风险。于 2011 年 12 月 31 日，本基金未持有的除国债、央行票据和政策性金融债以外的债券（2010 年 12 月 31 日：0.01%）。

7.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金所持金融工具变现的难易程度。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人每日对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

针对投资品种变现的流动性风险，本基金的基金管理人通过独立的风险管理部门设定流动性比例要求，对流动性指标进行持续的监测和分析，包括组合持仓集中度指标、组合在短时间内变现能力的综合指标、组合中变现能力较差的投资品种比例以及流通受限的投资品种比例等。本基金投资于一家公司发行的股票市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司发行的证券不得超过该证券的 10%。本基金所持大部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，因此除部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外，其余金融资产均能以合理价格适时变现。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。

本基金所持有的全部金融负债的合约约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值（所有者权益）无固定到期日且不计息，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

7.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

7.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。

本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

本基金持有的大部分金融资产和金融负债不计息，因此本基金的收入及经营活动的现金流量在很大程度上独立于市场利率变化。本基金持有的利率敏感性资产主要为银行存款、结算备付金及债券投资等。

7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2011 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以 上	不计息	合计
资产					
银行存款	21,626,092.81	-	-	-	21,626,092.81
结算备付金	136,974.45	-	-	-	136,974.45
存出保证金	-	-	-	299,850.47	299,850.47
交易性金融资产	-	-	-	376,385,573.24	376,385,573.24
应收证券清算款	-	-	-	186,048.81	186,048.81
应收利息	-	-	-	4,312.43	4,312.43
应收申购款	-	-	-	31,155.56	31,155.56
资产总计	21,763,067.26	-	-	376,906,940.51	398,670,007.77
负债					
应付赎回款	-	-	-	16,443.20	16,443.20
应付管理人报酬	-	-	-	223,637.44	223,637.44
应付托管费	-	-	-	41,286.92	41,286.92
应付交易费用	-	-	-	175,329.42	175,329.42
其他负债	-	-	-	663,990.94	663,990.94
负债总计	-	-	-	1,120,687.92	1,120,687.92
利率敏感度缺口	21,763,067.26	-	-	375,786,252.59	397,549,319.85
上年度末 2010 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以 上	不计息	合计
资产					
银行存款	24,905,028.75	-	-	-	24,905,028.75
结算备付金	6,805,064.71	-	-	-	6,805,064.71
存出保证金	-	-	-	630,219.46	630,219.46
交易性金融资产	90,938.60	-	-	589,500,657.15	589,591,595.75

应收利息	-	-	-	23,635.58	23,635.58
应收申购款	-	-	-	52,310.64	52,310.64
资产总计	31,801,032.06	-	-	590,206,822.83	622,007,854.89
负债					
应付赎回款	-	-	-	172,681.62	172,681.62
应付管理人报酬	-	-	-	366,352.31	366,352.31
应付托管费	-	-	-	67,634.29	67,634.29
应付交易费用	-	-	-	1,914,750.59	1,914,750.59
其他负债	-	-	-	645,072.85	645,072.85
负债总计	-	-	-	3,166,491.66	3,166,491.66
利率敏感度缺口	31,801,032.06	-	-	587,040,331.17	618,841,363.23

注：表中所示为本基金资产及负债的公允价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早予以分类。

7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于 2011 年 12 月 31 日，本基金未持有交易性债券投资 (2010 年 12 月 31 日：0.01%)，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响 (2010 年 12 月 31 日：同)。

7.4.13.4.2 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的股票和债券，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。

本基金的基金管理人在构建和管理投资组合的过程中，采用“自上而下”的策略，通过对宏观经济情况及政策的分析，结合证券市场运行情况，做出资产配置及组合构建的决定；通过对单个证券的定性分析及定量分析，选择符合基金合同约定范围的投资品种进行投资。本基金的基金管理人定期结合宏观及微观环境的变化，对投资策略、资产配置、投资组合进行修正，来主动应对可能发生的市场价格风险。

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。本基金投资于股票组合的比例不低于基金资产的 90%，投资组合中投资于中证财富大盘指数成份股的资产不低于股票资产的 90%，现金及到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%。此外，本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，包括 VaR (Value at Risk) 指标等来测试本基金面临的潜在价格风险，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

7.4.13.4.2.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2011 年 12 月 31 日		上年度末 2010 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金资产净值比例 (%)	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
交易性金融资产-股票投资	376,385,573.24	94.68	589,500,657.15	95.26
交易性金融资产-基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产-债券投资	-	-	-	-
衍生金融资产-权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	376,385,573.24	94.68	589,500,657.15	95.26

7.4.13.4.2.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准以外的其他市场变量保持不变			
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）		
		本期末（2011 年 12 月 31 日）	上年度末（2010 年 12 月 31 日）	
		业绩比较基准上升 5%	18,070,000.00	29,870,000.00
		业绩比较基准下降 5%	-18,070,000.00	-29,870,000.00

7.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

(1) 公允价值

(a) 不以公允价值计量的金融工具

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债，其账面价值与公允价值相差很小。

(b) 以公允价值计量的金融工具

(i) 金融工具公允价值计量的方法

根据在公允价值计量中对计量整体具有重大意义的最低层级的输入值，公允价值层级可分为：

第一层级：相同资产或负债在活跃市场上（未经调整）的报价。

第二层级：直接（比如取自价格）或间接（比如根据价格推算的）可观察到的、除第一层级中的市场报价以外的资产或负债的输入值。

第三层级：以可观察到的市场数据以外的变量为基础确定的资产或负债的输入值（不可观察输入

值)。

(ii) 各层次金融工具公允价值

于 2011 年 12 月 31 日, 本基金持有的以公允价值计量的金融工具中属于第一层级的余额为 375,374,747.99 元, 属于第二层级的余额为 1,010,825.25 元, 无属于第三层级的余额(2010 年 12 月 31 日: 第一层级 582,078,604.15 元, 第二层级 7,512,991.60 元, 无属于第三层级的余额)。本基金本期持有的以公允价值计量的金融工具的元, 无第三层级)。

(iii) 公允价值所属层次间的重大变动

对于证券交易所上市的股票和债券, 若出现重大事项停牌、交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)、或属于非公开发行等情况, 本基金分别于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间不将相关股票和债券的公允价值列入第一层级; 并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度, 确定相关股票和债券公允价值应属第二层级或第三层级。

(iv) 第三层次公允价值余额和本期变动金额

于本期末, 本基金未持有公允价值归属于第三层级的金融工具(2010 年 12 月 31 日: 同)。本基金本期净转入/(转出)第三层级零元, 计入损益的第三层级金融工具公允价值变动零元(2010 年度: 无), 涉及河南双汇投资发展股份有限公司(“双汇发展”)和吉林紫鑫药业股份有限公司(“紫鑫药业”)发行的股票。

(2) 除公允价值外, 截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

§ 8 投资组合报告

8.1 期末基金资产组合情况

金额单位: 人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	376,385,573.24	94.41
	其中: 股票	376,385,573.24	94.41
2	固定收益投资	-	-
	其中: 债券	-	-
	资产支持证券	-	-
3	金融衍生品投资	-	-
4	买入返售金融资产	-	-
	其中: 买断式回购的买入返售金融资产	-	-
5	银行存款和结算备付金合计	21,763,067.26	5.46
6	其他各项资产	521,367.27	0.13

7	合计	398,670,007.77	100.00
---	----	----------------	--------

8.2 期末按行业分类的股票投资组合

8.2.1 指数投资按行业分类的股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采掘业	34,031,032.15	8.56
C	制造业	85,930,683.61	21.62
C0	食品、饮料	9,944,993.67	2.50
C1	纺织、服装、皮毛	2,920,241.37	0.73
C2	木材、家具	241,684.00	0.06
C3	造纸、印刷	1,537,054.99	0.39
C4	石油、化学、塑胶、塑料	4,094,344.04	1.03
C5	电子	2,276,545.85	0.57
C6	金属、非金属	24,934,048.55	6.27
C7	机械、设备、仪表	32,702,344.63	8.23
C8	医药、生物制品	6,729,551.25	1.69
C99	其他制造业	549,875.26	0.14
D	电力、煤气及水的生产和供应业	16,370,817.41	4.12
E	建筑业	11,641,749.53	2.93
F	交通运输、仓储业	19,439,210.52	4.89
G	信息技术业	12,565,963.28	3.16
H	批发和零售贸易	7,416,194.27	1.87
I	金融、保险业	152,320,100.65	38.31
J	房地产业	26,244,735.17	6.60
K	社会服务业	3,197,811.08	0.80
L	传播与文化产业	367,883.57	0.09
M	综合类	3,901,914.20	0.98
	合计	373,428,095.44	93.93

8.2.2 积极投资按行业分类的股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采掘业	-	-

C	制造业	2,438,451.00	0.61
C0	食品、饮料	-	-
C1	纺织、服装、皮毛	-	-
C2	木材、家具	-	-
C3	造纸、印刷	-	-
C4	石油、化学、塑胶、塑料	1,135,430.85	0.29
C5	电子	76,510.00	0.02
C6	金属、非金属	362,444.00	0.09
C7	机械、设备、仪表	230,818.00	0.06
C8	医药、生物制品	633,248.15	0.16
C99	其他制造业	-	-
D	电力、煤气及水的生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	交通运输、仓储业	70,040.00	0.02
G	信息技术业	265,376.80	0.07
H	批发和零售贸易	-	-
I	金融、保险业	-	-
J	房地产业	-	-
K	社会服务业	183,610.00	0.05
L	传播与文化产业	-	-
M	综合类	-	-
	合计	2,957,477.80	0.74

8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

8.3.1 期末指数投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	600016	民生银行	3,335,705	19,647,302.45	4.94
2	600036	招商银行	1,436,656	17,053,106.72	4.29
3	601328	交通银行	3,755,298	16,823,735.04	4.23
4	601166	兴业银行	1,190,486	14,904,884.72	3.75
5	600000	浦发银行	1,570,778	13,335,905.22	3.35
6	601398	工商银行	2,174,299	9,219,027.76	2.32
7	600050	中国联通	1,691,006	8,860,871.44	2.23
8	000002	万科A	1,111,720	8,304,548.40	2.09
9	600030	中信证券	829,172	8,051,260.12	2.03
10	601318	中国平安	220,813	7,604,799.72	1.91
11	601088	中国神华	287,095	7,272,116.35	1.83

12	601939	建设银行	1,375,696	6,245,659.84	1.57
13	601169	北京银行	652,484	6,055,051.52	1.52
14	000001	深发展 A	349,342	5,446,241.78	1.37
15	600019	宝钢股份	1,088,797	5,280,665.45	1.33
16	601006	大秦铁路	701,649	5,234,301.54	1.32
17	600028	中国石化	679,113	4,876,031.34	1.23
18	601668	中国建筑	1,617,768	4,707,704.88	1.18
19	601601	中国太保	228,923	4,397,610.83	1.11
20	601288	农业银行	1,649,523	4,321,750.26	1.09
21	600048	保利地产	380,209	3,802,090.00	0.96
22	601857	中国石油	376,324	3,665,395.76	0.92
23	600900	长江电力	546,107	3,473,240.52	0.87
24	600015	华夏银行	302,662	3,398,894.26	0.85
25	600795	国电电力	1,168,144	3,259,121.76	0.82
26	600104	上海汽车	229,602	3,246,572.28	0.82
27	600837	海通证券	437,693	3,243,305.13	0.82
28	600383	金地集团	627,553	3,106,387.35	0.78
29	000858	五粮液	79,608	2,611,142.40	0.66
30	600519	贵州茅台	13,226	2,556,585.80	0.64
31	601009	南京银行	254,681	2,363,439.68	0.59
32	600011	华能国际	419,971	2,246,844.85	0.57
33	601628	中国人寿	124,171	2,190,376.44	0.55
34	000651	格力电器	124,957	2,160,506.53	0.54
35	000338	潍柴动力	67,144	2,115,036.00	0.53
36	600177	雅戈尔	221,439	2,077,097.82	0.52
37	002024	苏宁电器	239,719	2,023,228.36	0.51
38	601899	紫金矿业	524,830	2,004,850.60	0.50
39	601390	中国中铁	756,347	1,905,994.44	0.48
40	600585	海螺水泥	118,973	1,861,927.45	0.47
41	000402	金融街	306,425	1,853,871.25	0.47
42	000069	华侨城 A	255,823	1,826,576.22	0.46
43	601998	中信银行	447,305	1,807,112.20	0.45
44	000709	河北钢铁	585,998	1,675,954.28	0.42
45	600031	三一重工	133,325	1,671,895.50	0.42
46	601186	中国铁建	436,282	1,653,508.78	0.42
47	000157	中联重科	210,723	1,620,459.87	0.41
48	000063	中兴通讯	95,313	1,610,789.70	0.41
49	601898	中煤能源	177,411	1,598,473.11	0.40
50	600642	申能股份	316,865	1,454,410.35	0.37

51	600005	武钢股份	489,228	1,413,868.92	0.36
52	000825	太钢不锈	377,022	1,406,292.06	0.35
53	000527	美的电器	114,301	1,399,044.24	0.35
54	600089	特变电工	180,067	1,382,914.56	0.35
55	601919	中国远洋	293,645	1,374,258.60	0.35
56	601111	中国国航	213,059	1,357,185.83	0.34
57	600741	华域汽车	144,817	1,341,005.42	0.34
58	601618	中国中冶	505,015	1,333,239.60	0.34
59	600887	伊利股份	64,536	1,318,470.48	0.33
60	000024	招商地产	70,964	1,277,352.00	0.32
61	000898	鞍钢股份	276,644	1,258,730.20	0.32
62	601333	广深铁路	349,298	1,229,528.96	0.31
63	601699	潞安环能	57,452	1,215,684.32	0.31
64	000983	西山煤电	81,906	1,195,827.60	0.30
65	600029	南方航空	249,244	1,181,416.56	0.30
66	600660	福耀玻璃	144,330	1,157,526.60	0.29
67	600009	上海机场	94,474	1,156,361.76	0.29
68	600739	辽宁成大	92,807	1,140,598.03	0.29
69	600123	兰花科创	28,489	1,107,652.32	0.28
70	002142	宁波银行	120,850	1,106,986.00	0.28
71	601666	平煤股份	103,914	1,098,370.98	0.28
72	601788	光大证券	103,413	1,054,812.60	0.27
73	600348	阳泉煤业	68,816	1,044,626.88	0.26
74	600115	东方航空	274,048	1,041,382.40	0.26
75	600362	江西铜业	46,902	1,028,560.86	0.26
76	600690	青岛海尔	113,517	1,013,706.81	0.25
77	000568	泸州老窖	26,954	1,005,384.20	0.25
78	600875	东方电气	42,881	990,979.91	0.25
79	600808	马钢股份	390,907	969,449.36	0.24
80	601818	光大银行	324,069	933,318.72	0.23
81	600188	兖州煤业	41,136	921,035.04	0.23
82	000581	威孚高科	25,436	912,898.04	0.23
83	601299	中国北车	211,035	896,898.75	0.23
84	000422	湖北宜化	49,834	879,570.10	0.22
85	600886	国投电力	141,779	845,002.84	0.21
86	601766	中国南车	191,827	830,610.91	0.21
87	601168	西部矿业	87,976	824,335.12	0.21
88	600153	建发股份	127,205	811,567.90	0.20
89	601866	中海集运	333,129	809,503.47	0.20

90	000039	中集集团	62,890	808,136.50	0.20
91	000425	徐工机械	56,760	807,127.20	0.20
92	600068	葛洲坝	104,437	804,164.90	0.20
93	000900	现代投资	62,657	788,225.06	0.20
94	002202	金风科技	98,985	767,133.75	0.19
95	000800	一汽轿车	85,302	754,922.70	0.19
96	600166	福田汽车	127,333	739,804.73	0.19
97	600221	海南航空	163,544	732,677.12	0.18
98	000895	双汇发展	10,427	729,368.65	0.18
99	000783	长江证券	101,578	726,282.70	0.18
100	000401	冀东水泥	42,600	710,142.00	0.18
101	601688	华泰证券	89,518	700,030.76	0.18
102	600827	友谊股份	59,822	680,176.14	0.17
103	000937	冀中能源	40,292	679,323.12	0.17
104	601808	中海油服	46,631	675,683.19	0.17
105	000488	晨鸣纸业	144,306	675,352.08	0.17
106	601001	大同煤业	55,288	672,302.08	0.17
107	600999	招商证券	65,998	671,859.64	0.17
108	000933	神火股份	69,597	643,076.28	0.16
109	600376	首开股份	66,915	641,714.85	0.16
110	600309	烟台万华	49,396	637,208.40	0.16
111	600266	北京城建	50,992	631,790.88	0.16
112	000625	长安汽车	166,922	630,965.16	0.16
113	000528	柳 工	53,802	627,869.34	0.16
114	600150	中国船舶	23,986	621,237.40	0.16
115	000423	东阿阿胶	14,439	620,155.05	0.16
116	600839	四川长虹	288,686	617,788.04	0.16
117	600100	同方股份	70,132	617,161.60	0.16
118	601989	中国重工	118,051	603,240.61	0.15
119	600325	华发股份	82,204	594,334.92	0.15
120	600196	复星医药	68,904	588,440.16	0.15
121	600489	中金黄金	33,465	585,972.15	0.15
122	600269	赣粤高速	153,100	581,780.00	0.15
123	600380	健康元	98,162	580,137.42	0.15
124	600823	世茂股份	55,111	575,909.95	0.14
125	000027	深圳能源	94,319	575,345.90	0.14
126	600664	哈药股份	77,667	569,299.11	0.14
127	600066	宇通客车	23,939	566,396.74	0.14
128	000728	国元证券	66,615	566,227.50	0.14

129	000729	燕京啤酒	41,636	561,669.64	0.14
130	600138	中青旅	37,286	561,527.16	0.14
131	601607	上海医药	50,462	559,118.96	0.14
132	600508	上海能源	29,748	557,180.04	0.14
133	600600	青岛啤酒	16,480	551,750.40	0.14
134	600210	紫江企业	137,126	549,875.26	0.14
135	601727	上海电气	106,735	544,348.50	0.14
136	000539	粤电力 A	103,055	544,130.40	0.14
137	000616	亿城股份	169,157	541,302.40	0.14
138	600805	悦达投资	43,713	537,232.77	0.14
139	600219	南山铝业	83,873	530,916.09	0.13
140	600062	双鹤药业	33,982	530,119.20	0.13
141	600811	东方集团	96,546	530,037.54	0.13
142	000630	铜陵有色	31,398	527,800.38	0.13
143	601117	中国化学	90,713	517,064.10	0.13
144	601918	国投新集	46,009	512,080.17	0.13
145	601600	中国铝业	79,759	512,052.78	0.13
146	600216	浙江医药	25,445	506,101.05	0.13
147	600060	海信电器	42,188	501,193.44	0.13
148	600547	山东黄金	17,343	492,367.77	0.12
149	600256	广汇股份	23,839	490,606.62	0.12
150	002146	荣盛发展	55,220	485,936.00	0.12
151	600518	康美药业	43,293	485,747.46	0.12
152	600098	广州控股	68,611	474,102.01	0.12
153	600271	航天信息	23,553	467,762.58	0.12
154	000060	中金岭南	56,000	460,880.00	0.12
155	600350	山东高速	142,791	459,787.02	0.12
156	000562	宏源证券	42,082	451,119.04	0.11
157	600717	天津港	74,197	448,891.85	0.11
158	600820	隧道股份	56,493	444,599.91	0.11
159	600018	上港集团	169,516	439,046.44	0.11
160	600655	豫园商城	51,441	431,075.58	0.11
161	600033	福建高速	178,551	424,951.38	0.11
162	600415	小商品城	53,623	420,404.32	0.11
163	600208	新湖中宝	121,966	417,123.72	0.10
164	000538	云南白药	7,838	415,414.00	0.10
165	601872	招商轮船	142,477	411,758.53	0.10
166	000680	山推股份	45,553	409,065.94	0.10
167	000717	韶钢松山	150,851	407,297.70	0.10

168	000926	福星股份	57,222	405,131.76	0.10
169	600583	海油工程	73,588	404,734.00	0.10
170	600694	大商股份	12,119	403,320.32	0.10
171	600418	江淮汽车	67,629	403,068.84	0.10
172	000999	华润三九	23,226	401,809.80	0.10
173	000012	南玻A	44,301	401,367.06	0.10
174	600832	东方明珠	75,832	400,392.96	0.10
175	000100	TCL 集团	216,915	399,123.60	0.10
176	600528	中铁二局	80,710	397,900.30	0.10
177	600688	S 上石化	66,675	396,716.25	0.10
178	600863	内蒙华电	46,844	388,805.20	0.10
179	002028	思源电气	31,163	386,421.20	0.10
180	600010	包钢股份	93,415	384,869.80	0.10
181	600755	厦门国贸	98,365	384,607.15	0.10
182	600004	白云机场	61,188	378,753.72	0.10
183	600675	中华企业	101,339	377,994.47	0.10
184	601106	中国一重	118,858	377,968.44	0.10
185	600111	包钢稀土	10,016	376,902.08	0.09
186	600008	首创股份	72,283	375,871.60	0.09
187	600601	方正科技	138,382	372,247.58	0.09
188	000951	中国重汽	30,223	372,045.13	0.09
189	000878	云南铜业	23,003	370,348.30	0.09
190	000550	江铃汽车	18,457	368,955.43	0.09
191	600704	物产中大	46,993	368,425.12	0.09
192	600037	歌华有线	46,043	367,883.57	0.09
193	600742	一汽富维	18,348	366,960.00	0.09
194	000726	鲁泰A	46,611	364,498.02	0.09
195	600027	华电国际	111,748	364,298.48	0.09
196	601991	大唐发电	69,719	359,750.04	0.09
197	600635	大众公用	78,008	358,056.72	0.09
198	000869	张裕A	3,289	354,883.10	0.09
199	000839	中信国安	52,694	352,522.86	0.09
200	600881	亚泰集团	74,275	352,063.50	0.09
201	600143	金发科技	27,222	351,980.46	0.09
202	002001	新和成	17,743	348,827.38	0.09
203	600352	浙江龙盛	60,961	348,696.92	0.09
204	601588	北辰实业	126,165	344,430.45	0.09
205	600026	中海发展	57,707	341,625.44	0.09
206	000089	深圳机场	80,181	332,751.15	0.08

207	000006	深振业 A	80,709	330,906.90	0.08
208	600997	开滦股份	29,704	330,902.56	0.08
209	000768	西飞国际	45,217	328,275.42	0.08
210	000939	凯迪电力	30,711	325,536.60	0.08
211	600079	人福医药	16,784	323,427.68	0.08
212	600522	中天科技	20,197	322,748.06	0.08
213	600395	盘江股份	15,610	322,346.50	0.08
214	600125	铁龙物流	34,686	321,886.08	0.08
215	600303	曙光股份	45,650	319,550.00	0.08
216	600308	华泰股份	89,867	319,027.85	0.08
217	601179	中国西电	85,853	317,656.10	0.08
218	600067	冠城大通	51,809	315,516.81	0.08
219	000066	长城电脑	63,256	314,382.32	0.08
220	600569	安阳钢铁	117,519	313,775.73	0.08
221	600859	王府井	9,638	309,476.18	0.08
222	600276	恒瑞医药	10,502	309,178.88	0.08
223	000759	中百集团	36,222	306,075.90	0.08
224	600022	济南钢铁	88,461	305,190.45	0.08
225	601958	金钼股份	26,792	304,892.96	0.08
226	002078	太阳纸业	37,574	304,725.14	0.08
227	600584	长电科技	57,742	304,300.34	0.08
228	000778	新兴铸管	47,150	301,288.50	0.08
229	600835	上海机电	37,783	299,619.19	0.08
230	000159	国际实业	36,649	297,589.88	0.07
231	600649	城投控股	49,356	297,123.12	0.07
232	600096	云天化	19,843	295,263.84	0.07
233	000059	辽通化工	38,529	292,820.40	0.07
234	600611	大众交通	56,824	292,643.60	0.07
235	600236	桂冠电力	77,078	292,125.62	0.07
236	600064	南京高科	32,280	291,488.40	0.07
237	600500	中化国际	45,262	289,224.18	0.07
238	600307	酒钢宏兴	76,215	286,568.40	0.07
239	601158	重庆水务	47,681	286,562.81	0.07
240	600582	天地科技	15,485	286,472.50	0.07
241	600006	东风汽车	89,097	279,764.58	0.07
242	600550	天威保变	25,012	279,634.16	0.07
243	600323	南海发展	33,149	279,114.58	0.07
244	002007	华兰生物	10,982	274,659.82	0.07
245	000031	中粮地产	71,858	273,060.40	0.07

246	000850	华茂股份	49,737	271,066.65	0.07
247	600058	五矿发展	12,251	268,419.41	0.07
248	600449	宁夏建材	13,641	268,182.06	0.07
249	600782	新钢股份	55,967	266,402.92	0.07
250	600017	日照港	98,642	266,333.40	0.07
251	600282	南钢股份	95,768	266,235.04	0.07
252	600231	凌钢股份	48,279	265,051.71	0.07
253	000667	名流置业	121,578	265,040.04	0.07
254	000690	宝新能源	84,764	258,530.20	0.07
255	000608	阳光股份	67,287	257,709.21	0.06
256	600761	安徽合力	25,301	257,564.18	0.06
257	000877	天山股份	12,142	257,410.40	0.06
258	000876	新希望	15,268	255,739.00	0.06
259	000959	首钢股份	94,766	253,972.88	0.06
260	000601	韶能股份	76,565	250,367.55	0.06
261	600322	天房发展	77,874	249,975.54	0.06
262	600497	驰宏锌锗	19,092	249,532.44	0.06
263	600720	祁连山	27,047	245,857.23	0.06
264	000009	中国宝安	22,474	244,966.60	0.06
265	000636	风华高科	38,063	243,222.57	0.06
266	600978	宜华木业	65,320	241,684.00	0.06
267	600963	岳阳林纸	50,844	237,949.92	0.06
268	000792	盐湖股份	7,364	235,427.08	0.06
269	600546	山煤国际	9,682	234,788.50	0.06
270	601101	昊华能源	13,419	232,685.46	0.06
271	600970	中材国际	14,572	229,654.72	0.06
272	600663	陆家嘴	20,013	226,747.29	0.06
273	600160	巨化股份	11,269	225,943.45	0.06
274	600533	栖霞建设	68,454	224,529.12	0.06
275	600169	太原重工	38,592	219,588.48	0.06
276	600320	振华重工	46,521	218,648.70	0.05
277	600252	中恒集团	20,444	217,115.28	0.05
278	002128	露天煤业	15,976	214,078.40	0.05
279	600581	八一钢铁	28,896	211,229.76	0.05
280	600183	生益科技	29,213	210,917.86	0.05
281	600815	厦工股份	25,784	209,366.08	0.05
282	002048	宁波华翔	29,018	208,929.60	0.05
283	600295	鄂尔多斯	17,532	207,578.88	0.05
284	000540	中天城投	32,343	206,024.91	0.05

285	600895	张江高科	29,910	203,088.90	0.05
286	002073	软控股份	12,748	192,877.24	0.05
287	600685	广船国际	12,744	184,278.24	0.05
288	002122	天马股份	26,574	172,199.52	0.04
289	600170	上海建工	18,600	164,982.00	0.04
290	600801	华新水泥	11,720	149,195.60	0.04
291	002092	中泰化学	17,774	133,127.26	0.03
292	601107	四川成渝	36,543	126,804.21	0.03
293	002244	滨江集团	17,141	121,529.69	0.03
294	600971	恒源煤电	7,157	94,687.11	0.02
295	600239	云南城投	13,677	88,079.88	0.02
296	000718	苏宁环球	12,432	65,143.68	0.02

8.3.2 期末积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	000683	远兴能源	128,315	737,811.25	0.19
2	600085	同仁堂	28,205	395,716.15	0.10
3	600426	华鲁恒升	49,092	370,644.60	0.09
4	600718	东软集团	29,000	236,060.00	0.06
5	000612	焦作万方	20,200	219,574.00	0.06
6	601888	中国国旅	7,000	183,610.00	0.05
7	002294	信立泰	6,400	155,072.00	0.04
8	601268	二重重装	15,000	105,900.00	0.03
9	000927	一汽夏利	15,600	95,316.00	0.02
10	002422	科伦药业	1,900	82,460.00	0.02
11	600549	厦门钨业	2,600	77,142.00	0.02
12	600703	三安光电	7,000	76,510.00	0.02
13	600428	中远航运	17,000	70,040.00	0.02
14	600331	宏达股份	7,900	65,728.00	0.02
15	002242	九阳股份	3,800	29,602.00	0.01
16	002405	四维图新	1,460	29,316.80	0.01
17	600596	新安股份	4,150	26,975.00	0.01

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	601328	交通银行	21,821,161.18	3.53
2	600000	浦发银行	17,463,938.05	2.82
3	600016	民生银行	16,249,048.69	2.63
4	600036	招商银行	16,153,526.03	2.61
5	600050	中国联通	14,329,537.44	2.32
6	601166	兴业银行	14,101,504.24	2.28
7	600030	中信证券	9,564,048.26	1.55
8	000002	万科 A	9,058,794.77	1.46
9	601088	中国神华	8,271,221.63	1.34
10	601318	中国平安	8,207,308.34	1.33
11	601398	工商银行	8,076,523.95	1.31
12	600019	宝钢股份	6,896,808.09	1.11
13	601169	北京银行	6,593,242.80	1.07
14	601288	农业银行	6,423,463.11	1.04
15	601668	中国建筑	5,887,283.21	0.95
16	600519	贵州茅台	5,817,482.80	0.94
17	601006	大秦铁路	5,707,473.59	0.92
18	000858	五粮液	5,352,677.24	0.86
19	601939	建设银行	5,313,112.58	0.86
20	601299	中国北车	5,237,238.00	0.85

注：“买入金额”（或“买入股票成本”）、“卖出金额”（或“卖出股票收入”）均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

8.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	601328	交通银行	18,772,617.72	3.03
2	600050	中国联通	17,848,660.95	2.88
3	600016	民生银行	17,639,913.70	2.85
4	600036	招商银行	14,274,442.38	2.31

5	600000	浦发银行	14,035,236.48	2.27
6	601166	兴业银行	12,762,385.04	2.06
7	601088	中国神华	11,747,348.71	1.90
8	000002	万科A	9,908,249.23	1.60
9	600030	中信证券	9,784,392.90	1.58
10	601398	工商银行	8,801,822.28	1.42
11	601318	中国平安	8,390,716.08	1.36
12	600519	贵州茅台	7,165,230.39	1.16
13	600585	海螺水泥	6,804,442.36	1.10
14	000651	格力电器	6,521,234.69	1.05
15	000858	五粮液	6,380,719.72	1.03
16	600019	宝钢股份	6,067,994.95	0.98
17	601668	中国建筑	6,057,964.12	0.98
18	600015	华夏银行	5,952,687.71	0.96
19	601939	建设银行	5,869,938.74	0.95
20	601006	大秦铁路	5,697,455.32	0.92

注：“买入金额”（或“买入股票成本”）、“卖出金额”（或“卖出股票收入”）均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	625,970,958.55
卖出股票收入（成交）总额	734,599,951.41

注：“买入金额”（或“买入股票成本”）、“卖出金额”（或“卖出股票收入”）均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

8.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

8.9 投资组合报告附注

8.9.1 报告期内基金投资的前十名证券的发行主体未出现被监管部门立案调查的情况，在报告编制日前一年内未受到公开谴责、处罚。

8.9.2 基金投资的前十名股票均未超出基金合同规定的备选股票库。

8.9.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	299,850.47
2	应收证券清算款	186,048.81
3	应收股利	-
4	应收利息	4,312.43
5	应收申购款	31,155.56
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	521,367.27

8.9.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

8.9.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

8.9.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末指数投资前十名股票中未存在流通受限情况的说明。

8.9.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末积极投资前五名股票中未存在流通受限情况的说明。

8.9.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

§ 9 基金份额持有人信息

9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数 (户)	户均持有的基 金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份额 比例	持有份额	占总份 额比例
6,862	68,822.14	350,964,738.99	74.32%	121,292,783.46	25.68%

9.2 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金的情况

项目	持有份额总数 (份)	占基金总份额比例
基金管理公司所有从业人员持有本开放式基金	613,868.19	0.1300%

§ 10 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2010年4月23日）基金份额总额	1,165,158,636.81
本报告期期初基金份额总额	595,743,595.27
本报告期基金总申购份额	242,231,750.19
减：本报告期基金总赎回份额	365,717,823.01
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	472,257,522.45

§ 11 重大事件揭示

11.1 基金份额持有人大会决议

报告期内本基金没有召开份额持有人大会。

11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

- 1、 本报告期内本基金管理人未发生重大人事变动。
- 2、本报告期内，根据证监会《关于核准中国银行股份有限公司李爱华基金行业高级管理人员任职资格的批复》，李爱华先生担任本基金托管人——中国银行托管及投资者服务部总经理。因工作调动，董杰先生不再担任中国银行托管及投资者服务部总经理，刘慧军女士不再担任中国银行托管及投资者服务部副总经理。上述人事变动已按相关规定备案、公告。

11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期无涉及本基金管理人、基金财产、本基金托管人、基金托管业务的诉讼事项。

11.4 基金投资策略的改变

本报告期本基金无投资策略的变化。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本年度本基金未更换会计师事务所，本年度支付给普华永道中天会计师事务所有限公司审计费用为 9 万元，该审计机构对本基金已提供审计服务的年限为 2 年。

11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

报告期内，基金管理人、本基金托管人托管业务部门及其相关高级管理人员无受监管部门稽查或处罚的情况。

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
申银万国	1	817,708,240.20	60.19%	695,055.72	60.93%	-
安信证券	1	235,468,243.39	17.33%	191,317.21	16.77%	-
中信建投	1	168,517,425.45	12.41%	143,239.03	12.56%	-
国金证券	1	136,766,577.39	10.07%	111,124.23	9.74%	-
中银国际	1	-	-	-	-	-
湘财证券	1	-	-	-	-	-

注：1、本基金本报告期内无新增、减少租用券商交易单元。

2、交易席位选择的标准和程序

基金管理人负责选择代理本基金证券买卖的证券经营机构，使用其席位作为基金的专用交易席位，选择的标准是：

- (1) 经营规范，有较完备的内控制度；
- (2) 具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件，交易设施符合证券交易的需要
- (3) 能为基金管理人提供高质量的研究咨询服务。

11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
申银万国	527,826.70	99.36%	-	-	-	-
安信证券	-	-	-	-	-	-
中信建投	3,423.60	0.64%	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-
中银国际	-	-	-	-	-	-
湘财证券	-	-	-	-	-	-

11.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	《泰达宏利基金管理有限公司关于旗下基金调整长期停牌股票估值方法的公告》	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及公司网站	2011年9月27日
2	《泰达宏利基金管理有限公司关于旗下基金所持紫鑫药业(002118)股票估值调整的公告》	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及公司网站	2011年10月22日
3	《泰达宏利基金管理有限公司关于变更开放式基金业务规则的公告》	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及公司网站	2011年12月27日

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准基金募集的文件；
- 2、基金合同；
- 3、托管协议；
- 4、法律意见书；

- 5、基金管理人业务资格批件、营业执照；
- 6、基金托管人业务资格批件和营业执照；
- 7、中国证监会要求的其他文件。

12.2 存放地点

基金管理人和基金托管人的住所

12.3 查阅方式

基金投资者可在营业时间免费查阅，或基金投资者也可通过指定信息披露报纸（《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》）或登录本基金管理人互联网网址（<http://www.mfcteda.com>）查阅。

投资者对本报告书如有疑问，可咨询本基金管理人泰达宏利基金管理有限公司：客户服务中心电话：400-698-8888（免长话费）或 010-66555662 网址：<http://www.mfcteda.com>

泰达宏利基金管理有限公司
2012年3月26日